

POSUDEK VEDOUCÍHO BAKALÁŘSKÉ PRÁCE

Název: Stochastická integrace

Autor: Ondřej Týbl

SHRNUTÍ OBSAHU PRÁCE

Tématem práce je stochastická integrace vůči Wienerovu procesu jak v Itôově, tak Stratonovičově smyslu. Po zavedení potřebných pojmů v první kapitole je důraz kladen zejména na vlastnosti stochastických integrálů a jejich porovnání, což je obsahem druhé kapitoly. V případě Stratonovičova integrálu je možné v literatuře narazit na různé definice, které obecně nemusí vést na stejný objekt. To je v práci ukázáno na příkladu, kterému se věnuje poslední kapitola.

CELKOVÉ HODNOCENÍ PRÁCE

Téma práce. Téma práce je poměrně náročné a student jej zpracoval v souladu se zadáním. Zejména lze považovat za přínosné vyjasnění pojmu Stratonovičova integrálu.

Vlastní příspěvek. Téma práce bylo spíše kompilačního charakteru. Hlavní příspěvek studenta spočívá v podrobném rozpracování protipříkladu v sekci 3.1 z původního Yorova článku (který je napsán francouzsky).

Matematická úroveň. Matematická úroveň textu je velmi solidní.

Práce se zdroji. Téma práce vyžadovalo zpracování poměrně velkého množství literatury, kterou student řádně citoval.

Formální úprava. Formální stránku textu je v pořádku. Práce je relativně dobře čitelná, i když místy jsou některé výpočty dosti podrobné, což může zatemnit hlavní myšlenku důkazů.

ZÁVĚR

Práci považuji za vynikající a doporučuji ji uznat jako bakalářskou práci.

Bohdan Maslowski
14.6. 2017